

І. М. Посохов

**ТЕОРЕТИЧНІ ТА ПРАКТИЧНІ
АСПЕКТИ УПРАВЛІННЯ
РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ**



Ігор Посохов

**ТЕОРЕТИЧНІ ТА ПРАКТИЧНІ
АСПЕКТИ УПРАВЛІННЯ
РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ**

ХАРКІВ
ПВПП «СЛОВО»
2014

УДК 339.138
ББК 65.05
П74

Автор:

Ігор Михайлович Посохов – кандидат економічних наук, доцент

Рецензенти:

В.В. Максимов, доктор економічних наук, професор, завідувач кафедри економіки підприємства Східноукраїнського національного університету ім. В. Даля;

А.В. Гриньов, доктор економічних наук, професор, завідувач кафедри менеджменту та оподаткування Національного технічного університету «Харківський політехнічний інститут»;

В.Г. Шинкаренко, доктор економічних наук, професор кафедри менеджменту Харківського національного автомобільного університету.

Рекомендовано до друку вченою радою Національного технічного університету «Харківський політехнічний інститут»
(протокол № 12 від 24.12 2013 р.)

Посохов І. М.

П 74 - Теоретичні та практичні аспекти управління ризиками корпорацій: монографія / І.М. Посохов. – Х.: ПВПП «СЛОВО», 2014. – 499 с.
ISBN 978-617-7035-00-7

Висвітлено теоретичні та практичні аспекти управління ризиками сучасних корпорацій, досліджено категорія корпорація та її економічна сутність, сутність категорії ризик та управління ризиками корпорацій, наукові розробки закордонних, російських шкіл ризик-менеджменту та вітчизняних шкіл ризикології, існуючі підходи до управління ризиками корпорацій в економіці та корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом, методичне забезпечення управління ризиками корпорацій, комплексний аналіз фінансового стану корпорацій і оцінка ймовірності їх банкрутства, нечіткий аналіз ризиків корпорацій, що співпрацюють з залізничним транспортом, управління ризиками корпорацій, що співпрацюють з залізничним транспортом.

Для економістів, фахівців з управління, науковців, керівників та фахівців органів державного управління, керівників та топ-менеджерів корпорацій, фахівців та практиків, що цікавляться проблемами управління ризиками корпорацій.

ISBN 978-617-7035-00-7

УДК 339.138
ББК 65.05
© Посохов І. М., 2014

Зміст

ВСТУП.....	
Ошибка! Закладка не определена.	
РОЗДІЛ 1. ТЕОРЕТИЧНІ ОСНОВИ КОРПОРАТИВНОГО УПРАВЛІННЯ.....	О
шибка! Закладка не определена.	
1.1. Дослідження категорії корпорація та її економічної сутності.....	Ошибка! Закладка не определена.
1.2. Розвиток економіко-правового змісту категорії «корпорація».....	Ошибка! Закладка не определена.
1.3. Визначення передумов інноваційного розвитку сучасних корпорацій.....	О
шибка! Закладка не определена.	
1.4. Порівняльна характеристика моделей корпоративного управління в ринковій економіці: переваги та недоліки.....	Ошибка! Закладка не определена.
1.5. Модель корпоративного управління України: становлення, особливості, основні напрямки подальшого розвитку.....	Ошибка! Закладка не определена.
Висновки до розділу 1.....	Ошибка! Закладка не определена.
РОЗДІЛ 2. ТЕОРЕТИЧНІ АСПЕКТИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ, ЩО СПІВПРАЦЮЮТЬ ІЗ ЗАЛІЗНИЧНИМ ТРАНСПОРТОМ.....	О
шибка! Закладка не определена.	
2.1. Сутність категорії ризик та управління ризиками корпорацій.....	Ошибка! Закладка не определена.
2.2. Аналіз існуючих підходів до класифікації ризиків у цілому та на залізничному транспорті зокрема.....	Ошибка! Закладка не определена.
2.3. Дослідження факторів ризиків корпорацій, що співпрацюють із залізничним	

транспортом.....	Ошибка!
Закладка не определена.	
2.4. Існуючі підходи до управління ризиками корпорацій в економіці та корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортм.....	Ошибка! Закладка не определена.
2.5. Дослідження становлення та наукові розробки закордонних, російських шкіл ризик-менеджменту та вітчизняних шкіл ризикології...	Ошибка! Закладка не определена.
2.6. Дослідження міжнародних стандартів управління ризиками.....	Ошибка! Закладка не определена.84
Висновок до розділу 2.....	193
РОЗДІЛ 3. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ, ЩО СПІВПРАЦЮЮТЬ ІЗ ЗАЛІЗНИЧНИМ ТРАНСПОРТОМ.....	198
3.1. Сучасний стан розвитку методичного забезпечення управління ризиками.....	198
3.2. Розвиток класифікації методів управління ризиками корпорацій, що співпрацюють із залізничном транспортм.....	Ошибка! Закладка не определена.
3.3. Методи оцінки ризиків та їх класифікація.....	Ошибка! Закладка не определена.22
Висновки до розділу 3.....	Ошибка! Закладка не определена.
РОЗДІЛ 4 КОМПЛЕКСНИЙ АНАЛІЗ ФІНАНСОВОГО СТАНУ КОРПОРАЦІЙ, ЩО СПІВПРАЦЮЮТЬ ІЗ ЗАЛІЗНИЧНИМ ТРАНСПОРТОМ, І ОЦІНКА ЙМОВІРНОСТІ ЇХ БАНКРУТСТВА.....	Ошибка! Закладка не определена.51
4.1. Комплексний аналіз і рейтингова оцінка фінансового стану корпорації у цілому та тих підприємств, що співпрацюють із залізничним транспортм, зокрема.....	Ошибка!
Закладка не определена.51	

4.2. Аналіз адекватності використання зарубіжних моделей оцінки імовірності банкрутства для вітчизняних корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	276
4.3. Використання системи показників У. Бівера для оцінки ризику банкрутства корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	287
4.4. Аналіз російських та українських моделей оцінки імовірності банкрутства корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом, та адекватність їх застосування.....	294
Висновки	до розділу
4.....	Ошибка! Закладка не определена.06
РОЗДІЛ 5. НЕЧІТКИЙ АНАЛІЗ РИЗИКІВ КОРПОРАЦІЙ, ЩО СПІВПРАЦЮЮТЬ ІЗ ЗАЛІЗНИЧНИМ ТРАНСПОРТОМ.....	
	Ошибка! Закладка не определена.09
5.1. Система факторів аналізу фінансових ризиків корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	Ошибка! Закладка не определена.09
5.2. Факторний аналіз фінансового стану корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	Ошибка!
	Закладка не определена.15
5.3. Використання факторного аналізу до чинників фінансової стійкості, ділової активності, ліквідності і платоспроможності, рентабельності.....	332
5.4. Оцінка порогових значень узагальнених факторів фінансової стійкості корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	336
5.5. Оцінювання фінансового ризику корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом, за системою виводу Мамдані-Заде.....	349
Висновки до розділу 5.....	357
РОЗДІЛ 6. УПРАВЛІННЯ ОПЕРАЦІЙНИМИ РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ, ЩО СПІВПРАЦЮЮТЬ ІЗ ЗАЛІЗНИЧНИМ ТРАНСПОРТОМ.....	
	359
6.1. Узагальнені підходи до управління ризиками в корпораціях.....	359
6.2. Організаційно-економічний механізм корпоративної взаємодії в рамках корпоративної структури «МЕТЗАЛМАШБУДЕНЕРГО».....	366
6.3. Методика побудови системи управління ризиками корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом.....	373
6.4. Операційні ризики корпорацій, що співпрацюють із залізничним транспортом: управління та основні напрями зниження.....	381

6.5. Мотивація персоналу як фактор зниження операційного ризику.....	393
Висновки до розділу 6.....	397
ВИСНОВКИ.....	О

шибка! Закладка не определена.00

СПИСОК	ВИКОРИСТАНИХ
ДЖЕРЕЛ.....	Ошибка!
определена.07	Закладка не

ДОДАТКИ.....	455
Додаток А. Ейндховенська модель класифікації.....	456
Додаток Б.1. Алгоритм розрахунку основних фінансових показників....	458
Додаток В.1. Методика матричного методу прогнозування банкрутства на основі нечітких множин.....	482
Додаток В.2. Алгоритми розрахунку основних показників фінансового стану корпорації.....	489

Наукове видання

Посохов Ігор Михайлович

**ТЕОРЕТИЧНІ ТА ПРАКТИЧНІ АСПЕКТИ
УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ КОРПОРАЦІЙ:**

Монографія

Зауваження та пропозиції до монографії присилати на e-mail:
posokhov7@gmail.com

Здано до друку 05.01.2014. Підписано до друку 18.01.2014
Формат 60х84/16 Папір офсетний. Друк офсет.
Умов. друк. арк. 31,2. Зам. 21. Наклад – 300 прим.

Друкарня ПВПП «Слово»
61024, м. Харків, вул. Лермонтовська, 27
Тел.: (057) 759 72 28
Свідоцтво про внесення до державного реєстру:
ХК № 214 від 21.11.2007 р.